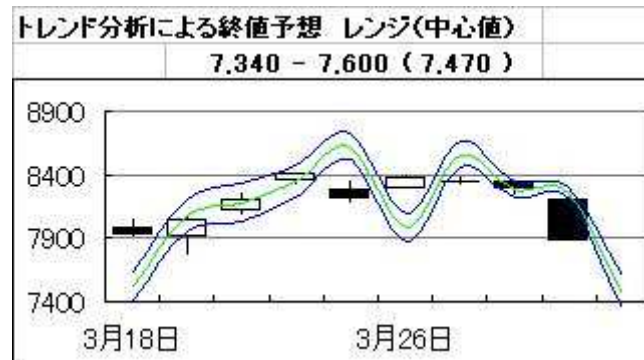


Daily Technical Report 解説

Stat Arb 青木俊郎

①トレンド分析による終値予想



概要:

- ・直近の相場におけるトレンドを用い、仮にそのトレンドが本日も継続した場合の終値予想を算出したもの。
- ・直近のボラティリティ(値動きの荒さ)を考慮し、予想終値(『中心値』)を中心にレンジを算出した。グラフ上では中心線が予想中心。上／下にある2線がレンジを示す。

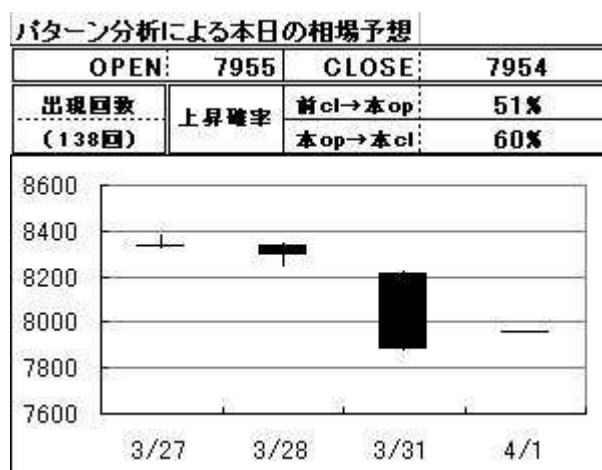
②ブレンドシステム 0305

ブレンドシステム 0305		昨日のポジション・損益		
(寄付成行、98年～コスト無視)		Short	8,060円	
本日シグナル	累積損益	勝率	損益/回	売買頻度
Short	12,900円	63.3%	45.1円	1.1回/週

概要:

- ・トレンド・オシレーター・パターンという、異なる複数のチャート手法を組み合わせで作成。
- ・執行はすべて寄付成り行き。オーバーナイトポジションを持つ。シグナル変更時はドテンの場合と、アンワインドのみの場合がある。
- ・ロスカットなどが設定されていないため、実際の運用上は別途リスクマネージメントを検討する必要がある

③パターン分析による本日の相場予想



概要:

- ・直近の4本値パターンを洗い出し、過去これと同パターンだったときの翌日の動きを平均化し、本日の動きを予想する。
- ・「OPEN/CLOSE」予想は値幅も考慮されているため(上昇・下落の期待値を基にした予想)、これが考慮されていない「上昇確率」(確率ベースでの予想)とは意味合いが異なるので注意。
- ・「前cl→本op」・・・前日大引け→本日寄り付きまでに相場が上昇する確率
- ・「本op→本cl」・・・本日寄り付き→本日大引けまでに相場が上昇する確率